

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BÁSICA 1, S.A. DE C.V., SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO
SOCIEDAD DE INVERSIÓN BÁSICA**

ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA AL 31 DE DICIEMBRE DE 2015 Y 2014

(Cifras en miles de pesos)

ACTIVO	2015	2014	PASIVO	2015	2014
DISPONIBLE			OBLIGACIONES		
Bancos moneda nacional	48	10	Acreedores	-	49,279
Bancos monedas extranjeras	60,312	34,278	Provisiones para gastos	1,722	914
Divisas por recibir	337	230	Pérdidas por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	1,005,303	1,234,309
	60,697	34,518	TOTAL PASIVO	1,007,025	1,284,502
INVERSIONES			CAPITAL CONTABLE	2015	2014
Inversión en valores de renta variable	330,243	387,651	CAPITAL		
Plus (Minus) valía en valores de renta variable	199,999	188,913	CAPITAL CONTRIBUIDO	5,077,489	4,748,059
Inversión en instr. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	6,292,790	5,926,781	Capital social pagado	6,512,506	6,360,207
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional de tasa real denom. en pesos y udís	683,207	1,120,621	Prima en venta de acciones	(1,435,017)	(1,612,148)
Inversión en instr. deuda nacional de tasa nominal denom. en pesos	4,047,313	4,213,643	CAPITAL GANADO	8,386,593	7,708,277
Plus (Minus) valía en instrum. deuda nacional de tasa nom. denom. en pesos	56,638	232,721	Resultados de ejercicios anteriores	7,708,277	7,156,175
Depósito Traspaso Banxico	5,655	6,044	Resultados del ejercicio	678,316	552,102
Plus (Minus) valía en inversión en el Depósito Traspaso Banxico	3	1	OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
Inversión en instrum. deuda nacional de tasa nominal en divisas distintas al peso	405,359	444,969	PLUS (MINUS) VALÍAS	1,079,610	1,685,999
Plus(Minus)valía instrum. deuda nacional tasa nominal divisas distintas al peso	84,016	74,121	TOTAL CAPITAL CONTABLE	14,543,692	14,142,335
Instrumentos otorgados en garantía por operaciones derivadas	19,306	-			
Plus (Minus) valía instrum. otorgados en garantía por operaciones derivadas	(104)	-	TOTAL PASIVO MAS CAPITAL	15,550,717	15,426,837
Aportaciones de Instrumentos Financieros Derivados Listados	28,024	63,308			
Inversión en valores extranjeros de deuda	463,117	531,412			
Plus (Minus) valía en Inversión en valores extranjeros de deuda	55,851	69,622			
Inversión en instrumentos de deuda por reporto	1,798,535	910,594			
Plus (Minus) valía de valores por reporto	3,026	93			
	14,472,978	14,170,494			
DEUDORES DIVERSOS					
Liquidadora	38	77,915			
Dividendos o derechos por cobrar	158	707			
Intereses devengados sobre valores	89,958	85,783			
Reportos	(3,356)	(88)			
Intereses devengados por instrumentos recibidos en reporto	2,973	788			
Utilidad por realizar de Instrumentos Financieros Derivados (OTC)	927,271	1,056,720			
	1,017,042	1,221,825			
TOTAL ACTIVO	15,550,717	15,426,837			

CUENTAS DE ORDEN	2015	2014	CUENTAS DE ORDEN	2015	2014
Valores entregados en custodia	12,643,393	13,196,499	Capital social autorizado	11,354,689	11,354,689
Valores entregados en custodia por reporto	1,801,177	911,387	Acciones emitidas	3,200,028,183	3,200,028,183
Bancos divisas en moneda extranjera	24,718	142,512	Acciones en circulación, posición propia	15,053,855	15,050,091
Dólares americanos	890	1,144	Acciones de Siefors, posición de terceros	1,127	1,127
Euros	2,235	1	Acciones en circulación propiedad de los trabajadores	1,820,328,134	1,777,410,232
Yenes	21,593	141,367			
Divisas por recibir	20	16			
Dólares americanos	20	16			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición larga	36,048,748	33,453,351			
Contratos Adelantados sobre Renta Fija (Bonos)	145,378	376,981			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	26,281	7,648			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	88,238	16,745			
Contratos Adelantados sobre Euros	132,408	-			
Contratos Adelantados sobre Yenes	-	6,626			
Contratos Futuros sobre Renta Variable Nacional	9,203	8,507			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	11,247,777	10,432,525			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	3,046,260	2,944,419			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,370,887	1,216,297			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	15,026,015	14,090,051			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	4,956,301	4,353,552			
Contratos abiertos en Instrumentos Financieros Derivados - Posición corta	37,219,256	34,290,547			
Contratos Adelantados sobre Renta Variable Extranjera	42,377	-			
Contratos Adelantados sobre Dólar Americano	811,873	-			
Contratos Adelantados sobre Euros	216,669	311,128			
Contratos Adelantados sobre Yenes	-	5,657			
Contratos Adelantados sobre Otras Divisas	58,178	-			
Contratos Futuros sobre Dólar Americano	444,031	937,662			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Pesos	13,391,447	11,987,753			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Dólar Americano	4,724,413	4,116,626			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en UDIS	1,911,624	2,379,004			
Contratos de Swaps sobre Tasa Fija en Euros	204,344	204,344			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Pesos	12,193,850	11,232,870			
Contratos de Swaps sobre Tasa Variable en Dólar Americano	3,220,450	3,115,503			

La Sociedad Valuadora de esta Sociedad de Inversión determinó:

Una plus (minus) valía de:	\$ 1,079,610	\$ 1,685,999
Un valor de los activos netos de:	\$ 14,543,692	\$ 14,142,335
El precio de la acción de:	\$ 7.924064	\$ 7.889896

GABRIEL VILLAGÓMEZ GÓMEZ
Contador General de SIEFORE

ENRIQUE SOLÓRZANO PALACIO
Director General

Los presentes estados financieros han sido formulados de acuerdo a las reglas de agrupación de cuentas establecidas por la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro y bajo la estricta responsabilidad de los funcionarios que suscriben.

COMISIÓN NACIONAL DEL SISTEMA DE AHORRO PARA EL RETIRO

**SIEFORE SURA BÁSICA 1, S.A. DE C.V., SOCIEDAD DE INVERSIÓN ESPECIALIZADA DE FONDOS PARA EL RETIRO
SOCIEDAD DE INVERSIÓN BÁSICA**

ESTADOS DE RESULTADOS INTEGRAL POR LOS PERIODOS DEL 1 DE ENERO AL 31 DE DICIEMBRE DE 2015 Y 2014

(Cifras en miles de pesos)

	2015	2014
Ingresos por la venta de Valores	3,359,562	3,022,344
Intereses, dividendos, premios y derechos	721,905	705,950
Resultado cambiario / Otros productos	81,118	27,445
Resultados por Intermediación con Instr. Financieros Derivados	(230,996)	(161,201)
INGRESOS NETOS	3,931,589	3,594,538
Costo de ventas de valores	3,080,011	2,873,352
Gastos generales	961	1,469
Comisiones sobre saldos	152,535	155,147
Intereses sobre inversiones en valores a entregar	19,765	12,468
EGRESOS NETOS	3,253,273	3,042,436
UTILIDAD DE OPERACIÓN	678,316	552,102
OTROS RESULTADOS INTEGRALES		
PLUS (MINUS) VALÍAS	1,079,610	1,685,999
UTILIDAD INTEGRAL DEL EJERCICIO	1,757,926	2,238,099

GABRIEL VILLAGÓMEZ GÓMEZ
Contador General de SIEFORE

ENRIQUE SOLÓRZANO PALACIO
Director General

Los presentes estados financieros han sido formulados de acuerdo a las reglas de agrupación de cuentas establecidas por la Comisión Nacional del Sistema de Ahorro para el Retiro y bajo la estricta responsabilidad de los funcionarios que suscriben.

NOTAS A LOS ESTADOS FINANCIEROS: En la Sesión del Consejo de Administración con fecha 27 de Noviembre 2015, fueron aprobados los Estados Financieros al 30 de Septiembre 2015 y 2014, así mismo, los presentes Estados Financieros al 31 de Diciembre de 2015 y 2014 serán aprobados en la sesión de Consejo de Administración que se llevara a cabo el próximo 4 de Febrero del 2016.